

ABSTRAK

Husniyah Ni'matul, 2014 SKRIPSI "Pengaruh Pencalonan Jokowi Menjadi Presiden 2014-2019 Terhadap *Abnormal Return* dan *Trading Volume Activity* di Bursa Efek Indonesia (Study Kasus Pada Kelompok Perusahaan LQ 45)".

Pembimbing : Drs. Agus Sucipto, MM.

Kata kunci : Pencapresan Jokowi, Harga Saham LQ-45, Event Study, *Abnormal Return* dan *Trading Volume Activity*

Penelitian ini dilatar belakangi oleh kondisi nilai IHSG yang bergerak kearah positif. Tujuan penelitian ini untuk melihat dan menganalisis perbedaan *Abnormal Return* dan *Trading Volume Activity* yang diperoleh investor terhadap harga saham yang disebabkan peristiwa Pengumuman Pencapresan Jokowi

Metode penelitian ini menggunakan metode kuantitatif deskriptif dengan pengambilan sampel populasi, data sekunder, dan dokumentasi. Teknik analisis data yang digunakan meliputi uji One sample t-Test dan Paired Sample t-Test yang berfungsi untuk membuktikan adanya perbedaan sebelum dan sesudah peristiwa.

Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwa peristiwa Pencapresan Jokowi mempengaruhi perubahan di BEI dilihat dari sisi *Abnormal Return* dan Aktivitas Volume Perdagangan. Dengan kata lain bahwa pasar modal Indonesia bereaksi terhadap peristiwa pengumuman Pencapresan Jokowi yang terlihat dari adanya perbedaan rata-rata *Abnormal Return* dan rata-rata aktivitas volume perdagangan (*Trading Volume Activity*) sebelum dan setelah peristiwa pengumuman Pencapresan Jokowi.